

富国天时货币市场基金
二〇一七年年度报告
(摘要)

2017年12月31日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2018年03月31日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

1.2

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富国天时货币			
基金主代码	100025			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2006年06月05日			
基金管理人	富国基金管理有限公司			
基金托管人	中国农业银行股份有限公司			
报告期末基金份额总额	28,716,487,787.37份			
基金合同存续期	不定期			
下属分级基金的基金简称	富国天时货币 A	富国天时货币 B	富国天时货币 C	富国天时货币 D
下属分级基金的交易代码	100025	100028	000862	000863
报告期末下属分级基金的份额总额 (单位:份)	474,216,272.47	28,217,674,606.15	11,315,018.59	13,281,890.16

2.2 基金产品说明

投资目标	在充分重视本金安全的前提下，确保基金资产的高流动性，追求超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金管理人借鉴外方股东加拿大蒙特利尔银行金融集团（BMO Financial Group）的投资管理经验及技能，结合国内市场的特征，应用“富国 FIPS—MMF 系统（Fixed Income Portfolio System—Money Market Fund）”，构建优质组合。在投资管理过程中，本基金管理人将基于“定性定量相结合、保守与积极相结合”的原则，根据短期利率的变动和市场格局的变化，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略。
业绩比较基准	当期银行个人活期存款利率（税前）。
风险收益特征	本基金属于风险较低、收益稳定、流动性较高的证券投资基金品种，但并不意味着投资本基金不承担任何风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人	
名称	富国基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	赵瑛	贺倩
	联系电话	021-20361858	010-66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话	95105686、4008880688	95599	

传真	021-20361634	010-68121816
----	--------------	--------------

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的 管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道 8 号 上海国金中心二期 16-17 层 中国农业银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

(1) 富国天时货币 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	14,968,150.50	16,917,304.70	26,253,982.43
本期利润	14,968,150.50	16,917,304.70	26,253,982.43
本期净值收益率	3.4178%	2.4667%	3.8704%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
期末基金资产净值	474,216,272.47	475,632,855.14	808,445,199.00
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000

(2) 富国天时货币 B

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	510,165,069.58	601,774,671.23	264,024,183.14
本期利润	510,165,069.58	601,774,671.23	264,024,183.14
本期净值收益率	3.6674%	2.7137%	4.1198%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
期末基金资产净值	28,217,674,606.15	22,525,457,321.02	12,643,882,626.06
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000

(3) 富国天时货币 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	400,051.82	414,401.77	1,058,466.00
本期利润	400,051.82	414,401.77	1,058,466.00
本期净值收益率	3.4235%	2.4685%	3.8741%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
期末基金资产净值	11,315,018.59	5,364,621.13	20,686,406.94
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日

累计净值收益率	10.1254%	6.4801%	3.9149%
---------	----------	---------	---------

(4) 富国天时货币 D

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	433,166.22	369,071.79	482,031.85
本期利润	433,166.22	369,071.79	482,031.85
本期净值收益率	2.9416%	1.8822%	3.2550%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
期末基金资产净值	13,281,890.16	17,281,899.69	22,543,438.20
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
累计净值收益率	8.9181%	5.8058%	3.8511%

注：上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用（例如，开放式基金的转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 富国天时货币 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9766%	0.0011%	0.0894%	0.0000%	0.8872%	0.0011%
过去六个月	1.9344%	0.0016%	0.1789%	0.0000%	1.7555%	0.0016%
过去一年	3.4178%	0.0021%	0.3549%	0.0000%	3.0629%	0.0021%
过去三年	10.0702%	0.0043%	1.0656%	0.0000%	9.0046%	0.0043%
过去五年	18.8851%	0.0038%	1.7753%	0.0000%	17.1098%	0.0038%
自基金合同生效日起至今	41.8067%	0.0050%	5.2927%	0.0004%	36.5140%	0.0046%

(2) 富国天时货币 B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0381%	0.0011%	0.0894%	0.0000%	0.9487%	0.0011%
过去六个月	2.0584%	0.0016%	0.1789%	0.0000%	1.8795%	0.0016%
过去一年	3.6674%	0.0021%	0.3549%	0.0000%	3.3125%	0.0021%
过去三年	10.8674%	0.0043%	1.0656%	0.0000%	9.8018%	0.0043%
过去五年	20.3218%	0.0038%	1.7753%	0.0000%	18.5465%	0.0038%
自基金合同生效日起至今	44.2557%	0.0050%	4.9387%	0.0004%	39.3170%	0.0046%

(3) 富国天时货币 C

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9778%	0.0011%	0.0894%	0.0000%	0.8884%	0.0011%
过去六个月	1.9378%	0.0016%	0.1789%	0.0000%	1.7589%	0.0016%
过去一年	3.4235%	0.0021%	0.3549%	0.0000%	3.0686%	0.0021%
过去三年	10.0821%	0.0043%	1.0656%	0.0000%	9.0165%	0.0043%
自基金合同生效日起至今	10.1254%	0.0043%	1.0685%	0.0000%	9.0569%	0.0043%

注：天时货币 C 级基金增设于 2014 年 10 月 29 日。基金净值表现数据起始日期为 2014 年 12 月 29 日，截止日期为 2017 年 12 月 31 日。

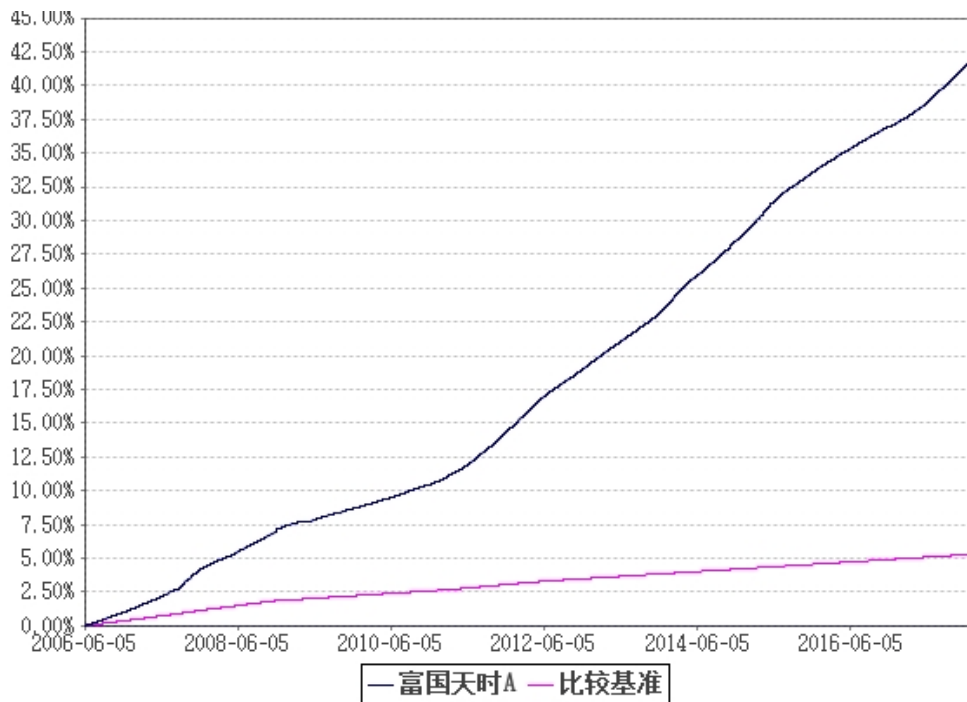
(4) 富国天时货币 D

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8257%	0.0011%	0.0894%	0.0000%	0.7363%	0.0011%
过去六个月	1.6296%	0.0016%	0.1789%	0.0000%	1.4507%	0.0016%
过去一年	2.9416%	0.0018%	0.3549%	0.0000%	2.5867%	0.0018%
过去三年	8.2929%	0.0042%	1.0656%	0.0000%	7.2273%	0.0042%
自基金合同生效日起至今	8.9181%	0.0043%	1.1219%	0.0000%	7.7962%	0.0043%

注：天时货币 D 级基金增设于 2014 年 11 月 3 日。基金净值表现数据起始日期为 2014 年 11 月 4 日，截止日期为 2017 年 12 月 31 日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

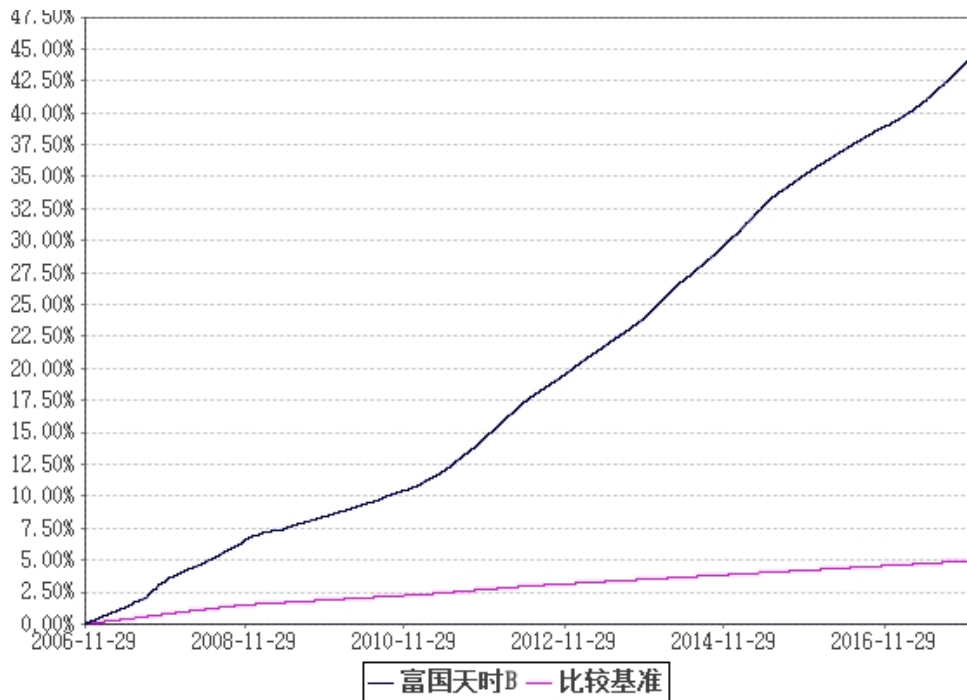
(1) 自基金合同生效以来富国天时货币 A 基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图：



注：1、截止日期为2017年12月31日。

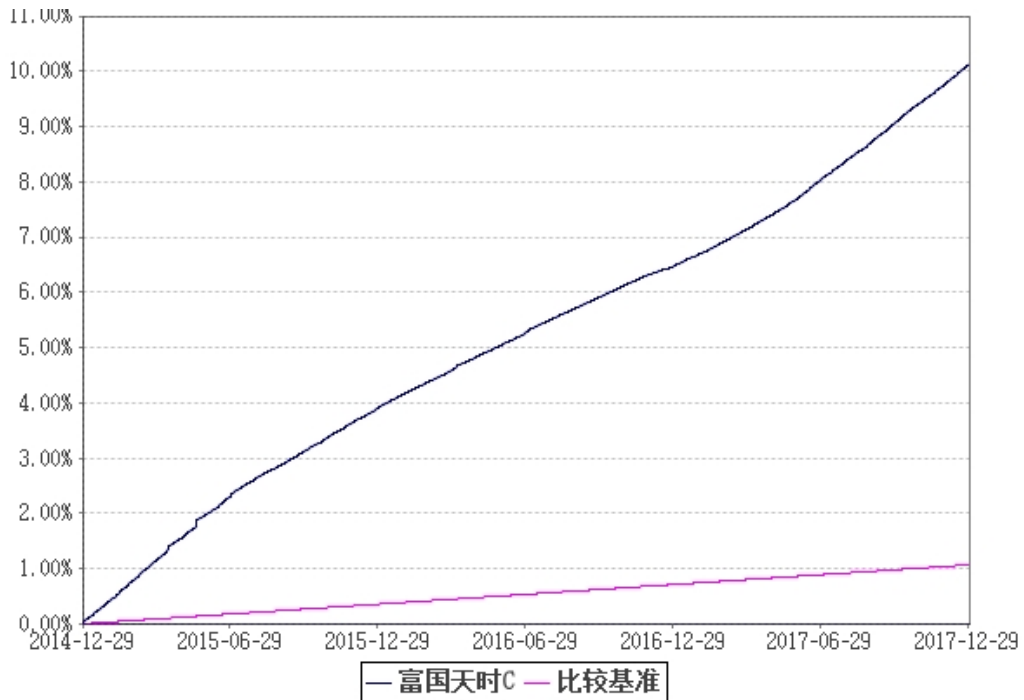
2、本基金于2006年6月5日成立，建仓期6个月，从2006年6月5日起至2006年12月4日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

(2) 自基金合同生效以来富国天时货币B基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图：



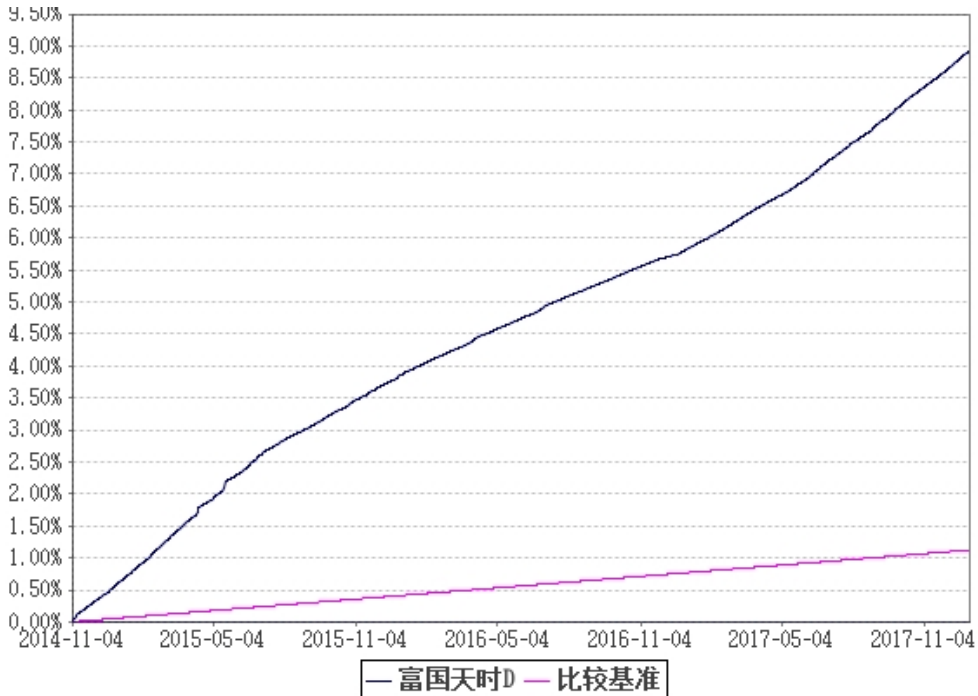
注：起始日期为2006年11月29日，截止日期为2017年12月31日。

(3) 自基金合同生效以来富国天时货币C基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图：



注：起始日期为 2014 年 12 月 29 日，截止日期为 2017 年 12 月 31 日。

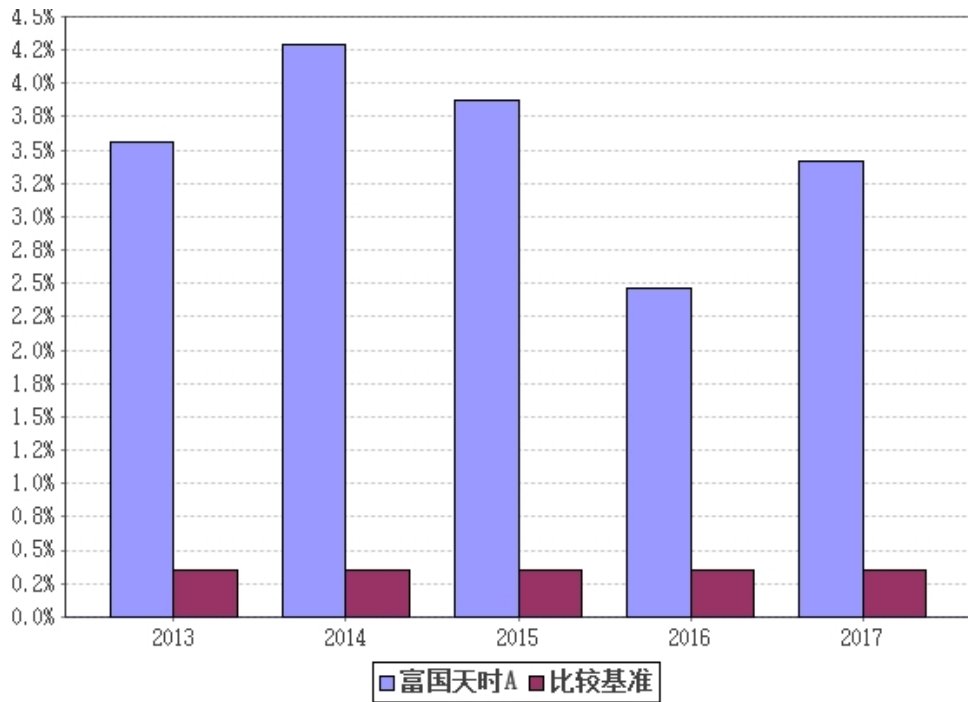
(4) 自基金合同生效以来富国天时货币 D 基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图：



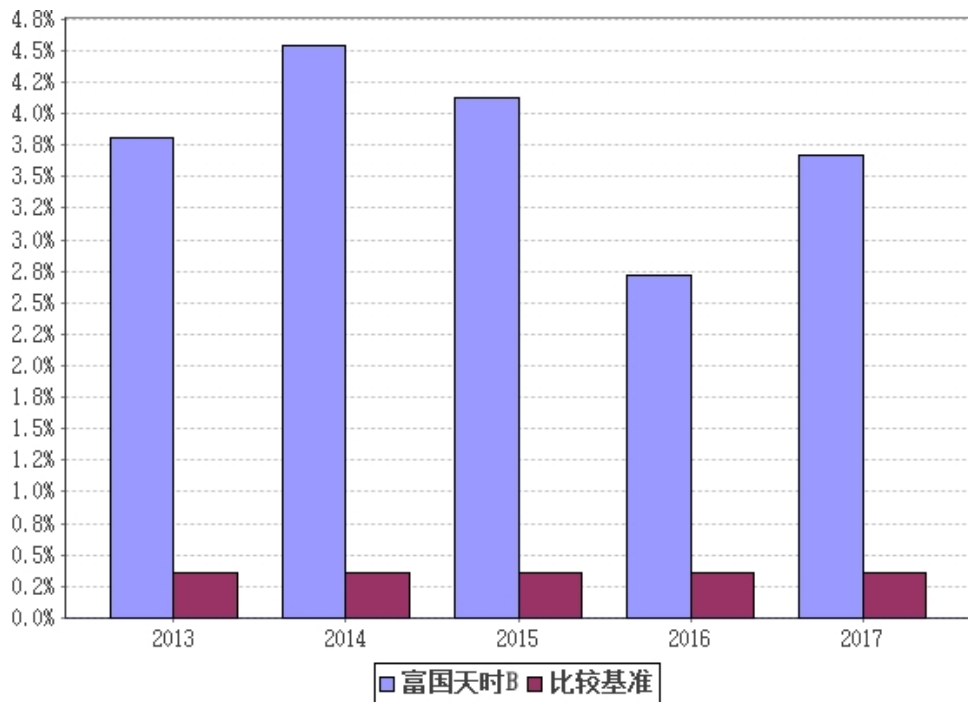
注：起始日期为 2014 年 11 月 4 日，截止日期为 2017 年 12 月 31 日。

3.2.3 过去五年以来基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图

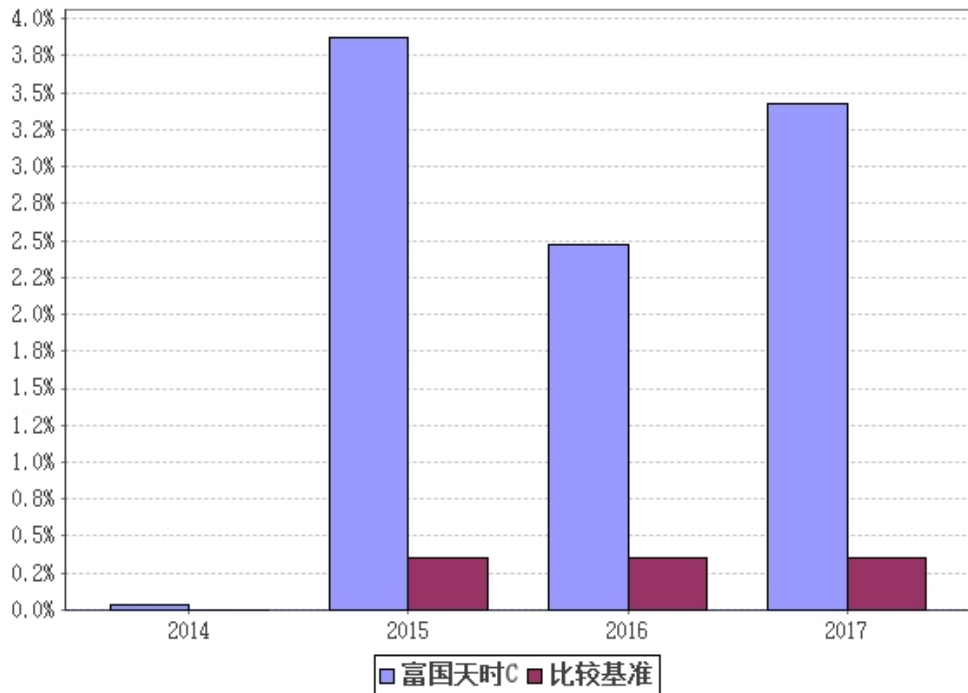
(1) 自基金合同生效以来富国天时货币 A 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



(2) 自基金分级以来富国天时货币 B 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图

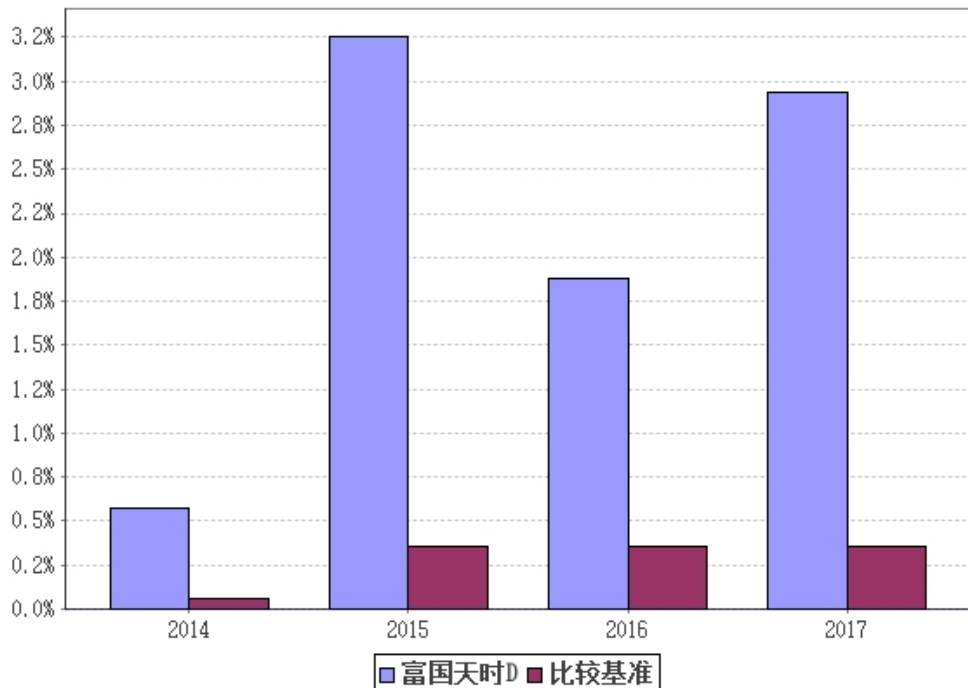


(3) 自基金分级以来富国天时货币 C 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2014 年按实际存续期计算。

(4) 自基金分级以来富国天时货币 D 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2014 年按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

(1) 富国天时货币 A

金额单位：人民币元

年度	已按再投资形式	直接通过应付	应付利润	年度利润	备注
----	---------	--------	------	------	----

	转实收基金	赎回款转出金额	本年变动	分配合计	
2017年	17,888,869.16	1,961,806.81	-4,882,525.47	14,968,150.50	—
2016年	26,113,451.99	2,334,495.60	-11,530,642.89	16,917,304.70	—
2015年	24,025,702.12	3,757,950.14	-1,529,669.83	26,253,982.43	—
合计	68,028,023.27	8,054,252.55	-17,942,838.19	58,139,437.63	—

(2) 富国天时货币 B

金额单位：人民币元

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2017年	377,980,260.54	86,460,755.10	45,724,053.94	510,165,069.58	—
2016年	520,673,437.53	68,624,322.87	12,476,910.83	601,774,671.23	—
2015年	231,023,576.35	20,235,942.89	12,764,663.90	264,024,183.14	—
合计	1,129,677,274.42	175,321,020.86	70,965,628.67	1,375,963,923.95	—

(3) 富国天时货币 C

金额单位：人民币元

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2017年	399,148.51	—	903.31	400,051.82	—
2016年	415,564.42	—	-1,162.65	414,401.77	—
2015年	1,056,901.08	—	1,564.92	1,058,466.00	—
合计	1,871,614.01	—	1,305.58	1,872,919.59	—

(4) 富国天时货币 D

金额单位：人民币元

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2017年	433,140.13	—	26.09	433,166.22	—
2016年	369,119.54	—	-47.75	369,071.79	—
2015年	481,203.15	—	828.70	482,031.85	—
合计	1,283,462.82	—	807.04	1,284,269.86	—

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于1999年4月13日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一，公司于2001年3月从北京迁址上海。2003年9月加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。截至2017年12月31日，

本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国消费主题混合型证券投资基金、富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值混合型证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选混合型证券投资基金、富国天博创新主题混合型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国优化增强债券型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金、富国通胀通缩主题轮动混合型证券投资基金、富国汇利回报两年定期开放债券型证券投资基金、富国全球债券证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国天盈债券型证券投资基金（LOF）、富国全球顶级消费品混合型证券投资基金、富国低碳环保混合型证券投资基金、富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）、富国产业债债券型证券投资基金、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金、富国高新技术产业混合型证券投资基金、富国中国中小盘（香港上市）混合型证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国强回报定期开放债券型证券投资基金、富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金、富国稳健增强债券型证券投资基金、富国信用债债券型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国医疗保健行业混合型证券投资基金、富国创业板指数分级证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富国城镇发展股票型证券投资基金、富国高端制造行业股票型证券投资基金、富国收益增强债券型证券投资基金、富国新回报灵活配置混合型证券投资基金、富国研究精选灵活配置混合型证券投资基金、富国中证军工指数分级证券投资基金、富国中证移动互联网指数分级证券投资基金、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金、富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金、富国富钱包货币市场基金、富国安益货币市场基金、富国中小盘精选混合型证券投资基金、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金、富国中证银行指数分级证券投资基金、富国文体健康股票型证券投资基金、富国国家安全主题混合型证券投资基金、富国改革动力混合型证券投资基金、富国新收益灵活配置混合型证券投资基金、富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金、富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金、富国中证煤炭指数分级证券投资基金、富国中证体育产业指数分级证券投资基金、富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金、富国新动力灵活配置混合型证券投资基金、富国收益宝交易型货币市场基金、富国低碳新经济混合型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国研究优选沪港深灵活配置混合型证券投资基金、富国价值优势混合型证券投资基金、富国泰利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国祥利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国美丽中国混合型证券投资基金、富国创新科技混合型证券投资基金、富国睿利定期开放混合型发起式证券投资基金、富国中证医药主题指数增强型证券投资基金（LOF）、富国两年期理财债券型证券投资基金、富国久利稳健配置混合型证券投资基金、富国富利稳健配置混合型证券投资基金、富国中证娱乐主题指数增强型证券投资基金（LOF）、富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）、富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国产业升级混合型证券投资

基金、富国鼎利纯债债券型发起式证券投资基金、富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）、富国泓利纯债债券型发起式证券投资基金、富国新优享灵活配置混合型证券投资基金、富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、富国祥利一年期定期开放债券型证券投资基金、富国丰利增强债券型发起式证券投资基金、富国兴利增强债券型发起式证券投资基金、富国嘉利稳健配置定期开放混合型证券投资基金、富国景利纯债债券型发起式证券投资基金、富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国精准医疗灵活配置混合型证券投资基金、富国研究量化精选混合型证券投资基金、富国沪港深行业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国金利定期开放混合型证券投资基金等九十八只证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
万莉	本基金基金经理兼任固定收益投资部现金投资总监，富国富钱包货币市场基金、富国安益货币市场基金、富国收益宝交易型货币市场基金基金经理	2015-10-09	—	12	硕士，自2006年7月至2008年6月在广州银行任债券交易员；自2008年6月至2013年7月在长信基金管理有限责任公司工作，历任债券交易员、基金经理助理、基金经理；自2013年7月至2014年6月在中融基金（原道富基金）管理有限公司工作，任现金管理投资总监；自2014年6月加入富国基金管理有限公司，自2014年6月至2015年10月任固定收益投资部现金管理主管；2015年10月起任富国天时货币市场基金、富国富钱包货币市场基金、富国安益货币市场基金基金经理；2015年12月起任富国收益宝交易型货币市场基金基金经理。现任固定收益投资部现金投资总监兼基金经理。具有基金从业资格。

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国天时货币市场基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国天时货币市场基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险，力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，管理和运用基金资产，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期，在同向交易价差分析方面，公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下，对同向交易价差进行t分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年全球经济延续复苏态势，经济持续扩张，通胀整体较为温和。美国

经济增长稳健，就业保持强劲，通胀则较为温和，在此基础上今年以来美联储总计加息 3 次，联邦基金利率从 0.5%-0.75%调升至 1.25%-1.5%。2017 年国内经济保持平稳增长，国内生产总值增长 6.9%。消费对经济增长的拉动依然强劲，投资增长稳中略缓，在全球经济复苏的带动下进出口增长较快。央行继续实施稳健中性的货币政策，主要通过逆回购和中期借贷便利调整市场流动性，全年央行上调逆回购和中期借贷便利利率 25BP。市场流动性受到季节性和临时性因素的影响增大，资金利率波动加大。

2017 年经济超预期的韧性、强监管环境以及稳健中性的货币政策主导货币市场。一季度，由于春节、缴税及季末 MPA 考核等多种因素，资金面呈现较大波动，利率中枢不断上行，央行多次调整货币政策工具的利率，调常备借贷便利 (SLF) 利率上调两次，隔夜、7 天、1 个月分别从 2.75%、3.25%、3.6%上调至 3.3%、3.45%、3.8%；中期借贷便利 (MLF) 和公开市场操作 (OMO) 各期限分别两次各上调了 10bp。二季度，透过基金规模缩水、银行理财大幅下降以及同业存单规模的变化，可以看出金融机构正在主动降低杠杆。从五月份开始，跨季资产价格不断提高，市场对于半年末资金面存在担忧情绪。然而央行依旧通过各类货币政策工具维护市场流动性，在五月底至六月初，通过 MLF 及 28 天逆回购，大量向市场投放流动性。在稳定市场资金预期后，央行在六月底并未展开任何逆回购操作，保持了市场紧平衡的状态。三季度七八月份缴税时点资金再次超预期紧张，带动跨季存单价格持续上行，9 月 6 日起，陆续投放 28 天 OMO，市场对跨季资金的忧虑有所减少，3 个月同业存单一级市场发行量剧增，随后随着银行需求陆续满足，利率逐渐走低。8 月 31 日证监会公布《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》，将于 10 月 1 日起施行，对货币基金将产生长远影响。四季度，十月份下旬的缴税导致月末市场资金骤紧，十二月份由于年末考核，跨年资金持续紧张，货币市场资金价格及各期限资产收益率快速达到年内新高。

2017 年全年，基金管理人严格按照基金合同进行投资管理，在资金面剧烈波动的环境中，优先保证基金资产的流动性和安全性，在此基础上提升货币基金的收益。基金管理人灵活地进行了资产配置，充分赚取骑乘和票息收益，根据市场情况调整资产配置比例、组合杠杆和剩余期限，从而较大地提升了货币基金抵御流动性风险的能力。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 12 月 31 日，本基金 7 日年化收益率 A 级为 4.051%，B 级为 4.304%，C 级为 4.061%，D 级为 3.439%；本报告期，本基金份额净值收益率 A 级为 3.4178%，B 级为 3.6674%，C 级为 3.4235%，D 级为 2.9416%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 0.3549%，B 级为 0.3549%，C 级为 0.3549%，D 级为 0.3549%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年，经济基本面、强监管环境以及稳健中性的货币政策将继续主导货币市场。受全球增长继续复苏和消费需求等支撑，2018 年国内经济仍将保持平稳增长，通胀中枢将有所上行。2017 年 12 月份中央经济工作会议要求稳健的货币政策要保持中性，管住货币供给总闸门，更好为实体经济服务，守住不发生系统性金融风险的底线。市场流动性受到季节性和临时性因素的影响仍将较大，资金利率波动仍较大。

基金管理人将继续保持谨慎操作的态度，在保证安全性和流动性的前提下，积极把握市场利率波动，合理调整资产配置比例、组合杠杆和剩余期限，尽量创

造更多的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期已按《基金合同》的约定：“1、基金收益分配方式为红利再投资，本基金 A、B 级基金份额的收益分配原则及支付方式采用‘每日分配、按月支付’；本基金 C、D 级基金份额的收益分配原则及支付方式采用‘每日分配、按日支付’”的条款进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人一富国基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为富国基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

本基金审计的注册会计师出具的是无保留意见的审计报告。
投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富国天时货币市场基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 (2017年12月31日)	上年度末 (2016年12月31日)
资产：		
银行存款	10,170,757,041.59	9,783,158,389.98
结算备付金	—	—
存出保证金	—	—
交易性金融资产	13,534,316,846.27	7,745,983,052.81
其中：股票投资	—	—
基金投资	—	—
债券投资	13,534,316,846.27	7,745,983,052.81
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	5,582,751,223.81	5,808,939,993.41
应收证券清算款	—	—
应收利息	113,892,979.95	139,456,047.86
应收股利	—	—
应收申购款	120,685.31	85,930,582.58
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	29,401,838,776.93	23,563,468,066.64
负债和所有者权益	本期末 (2017年12月31日)	上年度末 (2016年12月31日)
负债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	605,098,772.35	499,799,050.30
应付证券清算款	—	—
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	5,777,970.99	5,515,265.15

应付托管费	1,750,900.29	1,671,292.47
应付销售服务费	284,841.34	283,472.73
应付交易费用	154,797.84	176,345.68
应交税费	1,120,322.50	1,120,322.50
应付利息	402,138.64	206,075.60
应付利润	68,914,226.42	28,071,768.55
递延所得税负债	—	—
其他负债	1,847,019.19	2,887,776.68
负债合计	685,350,989.56	539,731,369.66
所有者权益：		
实收基金	28,716,487,787.37	23,023,736,696.98
未分配利润	—	—
所有者权益合计	28,716,487,787.37	23,023,736,696.98
负债和所有者权益总计	29,401,838,776.93	23,563,468,066.64

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 28,716,487,787.37 份，其中 A 级基金份额总额 474,216,272.47 份，其中 B 级基金份额总额 28,217,674,606.15 份，其中 C 级基金份额总额 11,315,018.59 份，其中 D 级基金份额总额 13,281,890.16 份。

7.2 利润表

会计主体：富国天时货币市场基金

本报告期：2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日)
一、收入	617,656,026.96	775,708,488.46
1. 利息收入	616,437,143.94	769,705,631.90
其中：存款利息收入	274,795,588.17	413,447,548.93
债券利息收入	265,964,080.31	341,655,034.63
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	75,677,475.46	14,603,048.34
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	1,218,883.02	6,002,856.56
其中：股票投资收益	—	—
基金投资收益	—	—
债券投资收益	1,218,883.02	6,002,856.56
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—
股利收益	—	—

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
减：二、费用	91,689,588.84	156,233,038.97
1. 管理人报酬	46,440,192.36	77,635,077.28
2. 托管费	14,072,785.57	23,525,781.00
3. 销售服务费	2,596,670.29	4,208,046.40
4. 交易费用	-	342.47
5. 利息支出	28,238,673.47	50,503,251.12
其中：卖出回购金融资产支出	28,238,673.47	50,503,251.12
6. 其他费用	341,267.15	360,540.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	525,966,438.12	619,475,449.49
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	525,966,438.12	619,475,449.49

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国天时货币市场基金

本报告期：2017年01月01日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 (2017年01月01日至2017年12月31日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	23,023,736,696.98	-	23,023,736,696.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	525,966,438.12	525,966,438.12
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	5,692,751,090.39	-	5,692,751,090.39
其中：1. 基金申购款	100,866,108,697.67	-	100,866,108,697.67
2. 基金赎回款	-95,173,357,607.28	-	-95,173,357,607.28
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-525,966,438.12	-525,966,438.12
五、期末所有者权益（基金净值）	28,716,487,787.37	-	28,716,487,787.37
项目	上年度可比期间 (2016年01月01日至2016年12月31日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	13,495,557,670.20	-	13,495,557,670.20

值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	619,475,449.49	619,475,449.49
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	9,528,179,026.78	—	9,528,179,026.78
其中: 1. 基金申购款	137,482,292,822.09	—	137,482,292,822.09
2. 基金赎回款	-127,954,113,795.31	—	-127,954,113,795.31
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	-619,475,449.49	-619,475,449.49
五、期末所有者权益(基金净值)	23,023,736,696.98	—	23,023,736,696.98

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

陈 戈	林志松	徐 慧
_____	_____	_____
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.2 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“农业银行”)	基金托管人、基金代销机构
申万宏源证券有限公司(“申万宏源”)	基金管理人的股东、基金代销机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
上海富国环保公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
富国资产管理(上海)有限公司(“富国资产”)	基金管理人的子公司
海通开元投资有限公司(“海通开元”)	基金管理人的股东控制的子公司
海通期货股份有限公司	基金管理人的股东控制的子公司

上海海通创世投资管理有限公司	基金管理人的股东控制的子公司
山东省国际信托股份有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.4.1.2 回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2017年01月01日至 2017年12月31日）	上年度可比期间（2016年01月 01日至2016年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	46,440,192.36	77,635,077.28
其中：支付销售机构的客户维护费	855,937.97	1,931,876.00

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.33%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2017年01月01日至 2017年12月31日）	上年度可比期间（2016年01 月01日至2016年12月31日）
当期发生的基金应支付的 托管费	14,072,785.57	23,525,781.00

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.4.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（2017年01月01日至2017年12月31日）				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	A级	B级	C级	D级	合计
富国基金管理有限公司	361,641.85	1,152,016.34	24,481.81	96,638.50	1,634,778.50
海通证券	6,452.44	2,467.24	—	—	8,919.68
申万宏源	3,373.35	1,159.34	—	—	4,532.69
农业银行	61,047.12	1,131.55	—	—	62,178.67
合计	432,514.76	1,156,774.47	24,481.81	96,638.50	1,710,409.54

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间（2016年01月01日至2016年12月31日）				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	A级	B级	C级	D级	合计
富国基金管理有限公司	455,310.32	1,972,246.88	42,106.30	162,709.49	2,632,372.99
申万宏源	4,829.49	19,928.30	—	—	24,757.79
农业银行	108,356.90	2,689.17	—	—	111,046.07
海通证券	12,344.92	4,774.36	—	—	17,119.28
合计	580,841.63	1,999,638.71	42,106.30	162,709.49	2,785,296.13

注：本基金A级、C级、D级基金份额的销售服务费按基金资产净值的0.25%年费率计提，销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日该级基金份额应计提的销售服务费

E 为前一日的该级基金份额基金资产净值

本基金B级基金份额的销售服务费按基金资产净值的0.01%年费率计提，销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.01\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日该级基金份额应计提的销售服务费

E 为前一日的该级基金份额基金资产净值

基金销售服务费在基金合同生效后每日计提，按月支付。

7.4.4.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期（2017年01月01日至2017年12月31日）						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
—	—	—	—	—	—	—

上年度可比期间（2016年01月01日至2016年12月31日）						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
—	—	—	—	—	—	—

7.4.4.4各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期(2017年01月01日至2017年12月31日)				上年度可比期间 (2016年01月01日至2016年12月31日)			
	富国天 时货币 A	富国天 时货币 B	富国天 时货币 C	富国天 时货币 D	富国天 时货 币A	富国天 时货币B	富国天 时货 币C	富国天 时货 币D
基金合同生效日2006年06月05日持有的基金份额	—	—	—	—	—	—	—	—
期初持有的基金份额	—	682,204,120.10	—	—	—	1,417,316,606.08	—	—
期间申购/买入总份额	—	135,449,792.33	—	—	—	875,134,581.63	—	—
期间因拆分变动份额	—	—	—	—	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	501,020,000.00	—	—	—	1,610,247,067.61	—	—
期末持有的基金份额	—	316,633,912.43	—	—	—	682,204,120.10	—	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	1.12%	—	—	—	3.03%	—	—

注：1. 本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

2. 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入及未付收益份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

富国天时货币 A:

份额单位: 份

关联方名称	本期末 (2017 年 12 月 31 日)		上期末 (2016 年 12 月 31 日)	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
上海富国环保公益基金会	2,271,147.63	0.48	2,203,938.14	0.46

富国天时货币 B:

份额单位: 份

关联方名称	本期末 (2017 年 12 月 31 日)		上期末 (2016 年 12 月 31 日)	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
富国资产管理 (上海) 有限公司	47,408,735.00	0.17	45,905,040.50	0.20
海通开元投资有限公司	310,107,179.98	1.10	300,271,303.45	1.33
海通期货股份有限公司	—	—	300,253,785.47	1.33
海通证券股份有限公司	1,002,128,058.24	3.55	801,347,608.82	3.56
上海海通创世投资管理有限公司	—	—	15,008,845.18	0.07

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 (2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日)		上年度可比期间 (2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日)	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	7,757,041.59	216,960.35	103,158,389.98	176,212.77

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注: 本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.4.7其他关联交易事项的说明

7.4.4.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联方交易事项。

7.4.5 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.5.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.5.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 605,098,772.35 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末估值总额
150207	15 国开 07	2018-01-03	99.97	1,050,000	104,963,318.13
170204	17 国开 04	2018-01-04	99.61	2,000,000	199,220,071.01
170410	17 农发 10	2018-01-04	99.60	3,400,000	338,629,650.45
合计				6,450,000	642,813,039.59

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的

金融资产中属于第一层次的余额为人民币 0.00 元，属于第二层次的余额为人民币 13,534,316,846.27 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元（于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 0.00 元，属于第二层次的余额为人民币 7,745,983,052.81 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元）。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	13,534,316,846.27	46.03
	其中：债券	13,534,316,846.27	46.03
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	5,582,751,223.81	18.99
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
3	银行存款和结算备付金合计	10,170,757,041.59	34.59
4	其他资产	114,013,665.26	0.39
5	合计	29,401,838,776.93	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额		6.68
	其中：买断式回购融资		—
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	605,098,772.35	2.11

其中：买断式回购融资	—	—
------------	---	---

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

注：本报告期内本基金不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的情况。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	63
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	115
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	43

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	45.21	2.11
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
2	30 天(含)—60 天	6.14	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
3	60 天(含)—90 天	23.66	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
4	90 天(含)—120 天	8.75	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
5	120 天(含)—397 天(含)	18.23	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
	合计	101.99	2.11

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例
----	------	------	-----------

			(%)
1	国家债券	149,814,180.65	0.52
2	央行票据	—	—
3	金融债券	1,625,631,647.90	5.66
	其中：政策性金融债	1,625,631,647.90	5.66
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	999,964,430.54	3.48
6	中期票据	—	—
7	同业存单	10,758,906,587.18	37.47
8	其他	—	—
9	合计	13,534,316,846.27	47.13
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	—	—

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	111709493	17 浦发银行 CD493	7,500,000.00	742,753,666.57	2.59
2	111716298	17 上海银行 CD298	5,000,000.00	498,281,627.55	1.74
3	111719391	17 恒丰银行 CD391	5,000,000.00	495,170,872.30	1.72
4	111713066	17 浙商银行 CD066	4,000,000.00	399,561,359.17	1.39
5	111780871	17 杭州银行 CD132	4,000,000.00	399,556,541.81	1.39
6	111719221	17 恒丰银行 CD221	4,000,000.00	399,030,715.98	1.39
7	130415	13 农发 15	4,000,000.00	398,940,651.64	1.39
8	111711527	17 平安银行 CD527	4,000,000.00	396,103,509.53	1.38
9	170410	17 农发 10	3,400,000.00	338,629,650.45	1.18
10	111709483	17 浦发银行 CD483	3,000,000.00	297,372,770.52	1.04

8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0688%
报告期内偏离度的最低值	-0.0966%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0305%

注：以上数据按工作日统计

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本报告期内本基金不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本报告期内本基金不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为人民币 1.00 元。本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益或损失。

8.9.2 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	113,892,979.95
4	应收申购款	120,685.31
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	114,013,665.26

8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
富国天时货	37,309	12,710.51	69,801,174.53	14.72	404,415,097.94	85.28

币 A						
富国天时货币 B	139	203,004,853.28	28,183,965,514.30	99.88	33,709,091.85	0.12
富国天时货币 C	786	14,395.70	—	—	11,315,018.59	100.00
富国天时货币 D	7,618	1,743.49	—	—	13,281,890.16	100.00
合计	45,852	626,286.48	28,253,766,688.83	98.39	462,721,098.54	1.61

9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	保险类机构	1,664,372,931.70	5.80
2	保险类机构	1,501,783,277.97	5.23
3	银行类机构	1,500,000,000.00	5.22
4	券商类机构	1,018,661,331.96	3.55
5	保险类机构	1,017,811,450.97	3.54
6	其他机构	1,004,579,449.90	3.50
7	券商类机构	1,002,128,058.24	3.49
8	银行类机构	1,000,000,000.00	3.48
9	银行类机构	1,000,000,000.00	3.48
10	基金类机构	940,000,000.00	3.27

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理公司所有从业人员持有本基金	富国天时货币 A	663,734.76	0.1400
	富国天时货币 B	—	—
	富国天时货币 C	2.63	0.0000
	富国天时货币 D	—	—
	合计	663,737.39	0.0023

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基	富国天时货币 A	0~10
	富国天时货币 B	0

金	富国天时货币 C	0
	富国天时货币 D	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	富国天时货币 A	0
	富国天时货币 B	0
	富国天时货币 C	0
	富国天时货币 D	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	A 级	B 级	C 级	D 级
基金合同生效日(2006年06月05日) 基金份额总额	3,518,813.0 10.23	—	—	—
报告期期初基金份额总额	475,632,855 .14	22,525,457,32 1.02	5,364,621.13	17,281,899. 69
本报告期基金总申购份额	1,088,236,5 61.81	99,643,260,30 3.07	119,027,088.80	15,584,743. 99
减：本报告期基金总赎回份额	1,089,653,1 44.48	93,951,043,01 7.94	113,076,691.34	19,584,753. 52
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	—	—	—	—
报告期期末基金份额总额	474,216,272 .47	28,217,674,60 6.15	11,315,018.59	13,281,890. 16

注：红利再投资和基金转换转入作为本期申购资金的来源，统一计入本期总申购份额，基金转换转出作为本期赎回资金的来源，统一计入本期总赎回份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人于 2016 年 8 月 29 日任命史静欣女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理，负责管理证券投资基金托管业务。因工作需要，余晓晨先生于 2017 年 3 月 8 日不再担任中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理职务。

本报告期本基金管理人于 2017 年 4 月 20 日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站上做公告，范伟隽先生不再担任本公司督察长，由赵瑛女士出任公司督察长。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所的报酬为9万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为15年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券回购交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东方证券	1	-	-	-	-	-

注：我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期本基金退租券商交易单元：中信证券（097500），中银国际（334400）。其余租用券商交易单元未发生变动。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期内无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017-05-25 至 2017-06-12	245,928,139.04	5,987,365,834.84	-3,030,000.00	3,203,293,973.88	11.15%
	2	2017-01-09 至 2017-06-26	3,938,446,933.73	2,480,537,337.35	-4,044,811,278.00	2,374,172,993.08	8.27%
	3	2017-04-07 至 2017-04-11	1,500,000.00	1,025,378,929.42	-2,119,637,981.19	405,740,948.23	1.41%
	4	2017-04-19 至 2017-05-04	-	4,518,467,082.57	-4,518,467,082.57	-	-

产品特有风险

本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风

险等特有风险。